中银互利分级债券型证券投资基金之互利A份额开放申购、赎回期间互利B份额（150156）风险提示公告

中银互利分级债券型证券投资基金(以下简称“本基金”)基金合同已于2013年9月24日生效。根据本基金基金合同的规定，本基金基金份额分为互利A份额（场内简称：中银互A，基金代码：163826）和互利B份额（场内简称：中银互B，基金代码：150156）两级份额，两级份额的份额配比原则上不超过7:3，互利A份额获得应计约定收益，互利B份额获得扣除互利A份额本金和应计约定收益后的基金剩余净资产。本基金2年为一个分级运作周期，在每个分级运作周期内，互利A份额自分级运作周期起始日起每6个月开放一次申购、赎回（第四个开放日仅开放赎回，不开放申购），并于开放日对基金份额进行折算。2016年9月29日为互利A份额第二个分级运作周期内第二个开放日及基金份额折算基准日。现就相关事项提示如下：

1、互利B份额收益分配变化的风险。根据本基金基金合同规定，在互利A份额的每个开放日，基金管理人根据该日中国人民银行公布并执行的金融机构人民币1年期定期存款基准年利率和基金管理人公告的利差重新设定互利A份额的年约定收益率，计算公式如下:

互利A份额的年约定收益率 = 1.1×一年期定期存款利率+利差

本基金第二个分级运作周期的第二个开放日下6个月内，互利A适用的利差值为1.5%。

基金管理人将根据2016年9月29日中国人民银行公布并执行的金融机构人民币一年期银行定期存款基准利率重新设定互利A年化约定收益率中的一年期定期存款利率值，用于计算下6个月的每日约定收益。

互利A份额的应计收益的金额采用单利计算。互利A份额的年化约定收益率计算按照四舍五入的方法保留到小数点后2位。

2、互利B份额杠杆率变动的风险。目前，互利A份额与互利B份额的份额配比为1:1.80。本次互利A份额开放申购、赎回并实施基金份额折算后，互利A份额的份额余额原则上不得超过7/3倍互利B份额的份额余额。如果互利A份额的申购申请小于赎回申请，互利A份额的份额规模将缩减，从而引致份额配比变化风险，进而出现杠杆率变动风险等。

基金管理人将向深圳证券交易所申请互利B份额自2016年9月23日9:30至10:30停牌一小时，以及2016年9月29日至2016年9月30日实施停牌。本次互利A份额开放申购、赎回并实施基金份额折算后，基金管理人将对互利A份额

开放申购、赎回及办理基金份额折算的结果进行公告。

风险提示：

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩及其净值高低并不预示其未来业绩表现。基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则，在做出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资者自行负担。

投资者投资基金前应认真阅读基金合同、招募说明书等法律文件，了解拟投资基金的风险收益特征，并根据自身投资目的、投资期限、投资经验、资产状况等判断基金是否和投资者的风险承受能力相匹配。

特此公告。

中银基金管理有限公司

2016 年 9 月 23 日